

# 上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金

## 更新招募说明书

### （2013 年第一号）摘要

**基金管理人：国泰基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

### 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]11 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

在投资本基金前，投资人应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

根据基金合同的相关规定，本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限，对于超出设定份额上限的申购、赎回申请，基金管理人有权予以拒绝。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金采用优化抽样复制法跟踪标的指数，但由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数成份券之间存在差异、基金估值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所

载内容截止日为 2013 年 9 月 5 日，投资组合报告为 2013 年 2 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 6 月 30 日。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

成立日期：1998 年 3 月 5 日

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何晔

联系电话：021-38569000，4008888688

股本结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

### （二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2013 年 9 月 5 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 39 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱

动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

### （三）主要人员情况

#### 1. 董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，21 年证券从业经历。1982 年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理，1998 年 3 月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999 年 10 月起任公司董事长、党委书记。

庄乾志，董事，博士研究生，高级经济师。1999 年 8 月至 2004 年 12 月在中国建设银行总行工作，历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005 年 1 月至 2007 年 7 月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司重组办公室主任。2007 年 8 月至 2009 年 2 月在西南证券有限责任公司任董事、党委委员及副总裁。2009 年 2 月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任资本市场部负责人、战略部负责人，现任中国建银投资有限责任公司办公室（党办、董监办）主任。2012 年 4 月起任公司董事。

林川，董事，博士研究生。2006 年 6 月至 2009 年 1 月在美国华盛顿互惠银行任高级计量

分析师。2009 年 2 月至 2009 年 7 月在美国富升人寿保险任财务经理。2010 年 3 月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部风险管理二组负责人。2012 年 4 月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生。1991 年起历任 BARCLAYS BANK 金融分析师；1993 年起任 BOISSY GESTION SA (AZUR-GMF) 首席执行官；2003 年起任 ROTHCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监；2004 年起任 GENERALI FINANCES SA 副总经理、投资总监；2007 年起任 GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官、投资总监；2009 年起任 GENERALI INVESTMENTS 董事会主席/首席执行官。2011 年起任 Generali Group 首席投资官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡) 主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano) 董事会成员等职务。2010 年 6 月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员 (FCII) 及英国特许保险师 (Chartered Insurer)。1989 年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994 年起任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996 年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998 年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002 年起任中意人寿保险有限公司董事。2007 年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010 年 6 月起任公司董事。

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994 年 3 月至 2002 年 2 月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。2002 年 2 月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012 年 4 月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，20 年证券从业经历。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007 年 5 月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007 年 11 月起任公司董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993 年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001 年 5 月起任公司独立董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986 年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任国务院学位委

员会第六届学科评议组法学组成员、全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2010 年 6 月起任公司独立董事。

刘秉升，独立董事，大学学历，高级经济师。1980 年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记；1982 年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长；1985 年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长；1989 年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记；1995 年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记；1998 年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007 年任海南省银行业协会会长。2010 年 11 月起任公司独立董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。1964 年起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。2003 年至 2008 年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010 年 11 月起任公司独立董事。

## 2. 监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科，高级工程师。1982 年 1 月至 1988 年 10 月在煤炭工业部基建司任工程师；1988 年 10 月至 1993 年 7 月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993 年 7 月至 1995 年 9 月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995 年 9 月至 1998 年 10 月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998 年 10 月至 2005 年 1 月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005 年 1 月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010 年 11 月起任公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967 年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官、忠利集团兼并收购及企业融资部总监，并在 Generali Horizon S.p.A., Trieste(IT)、BG Fiduciaria SIM 兼任董事会主席及 Autovie Venete S.p.A.、Banca Generali S.p.A.、Flandria(B)、Generali Investments Italy SGR S.p.A., Trieste(IT)、Generali Investments SICAV(Lux)、Generali Finance B.V., Diemen(NL)、Generali Investissement, Parigi(FR)、Genirland(IRL)、Generali Multinational Pension Solutions SICAV(Lux)、Graafschap Holland N.V., Diemen(NL)、La Centrale Finanziaria Generale S.p.A.、Net Engineering International S.p.A., Padova(IT)、Perseo S.p.A., Torino(IT)、Premuda S.p.A., Genvoa(IT)、Transocean Holding Corporation(USA)等公司兼任董事。2010 年 6 月起任公司监事。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。1986 年 7 月至 2000 年 3 月在中国人民解放军军事经济学院工作，历任教员、副主任。2000 年 4 月至 2003 年 1 月在长江证券有限责任公司工作，历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003 年 1 月至 2005 年 5 月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005 年 6 月起在中国电力财务有限公司工作，先后任金融租赁公司筹建处综合部主任，营业管理部主任助理，华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席，福建业务部副主任、主任，现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012 年 4 月起任公司监事。

沙骏，监事，硕士研究生。1998 年 5 月至 1999 年 11 月任职于国泰君安证券，1999 年 11 月至 2000 年 11 月任职于平安保险集团，2000 年 11 月至 2008 年 1 月任职于宝盈基金管理有限公司。2008 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任交易管理部总监、研究部总监。现任公司投资总监兼基金经理。2010 年 11 月起任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，2010 年 10 月至 2013 年 6 月任运营管理部负责人。现从事电子商务营销工作。2007 年 11 月起任公司职工监事。

### 3. 高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，20 年证券基金从业经历。1993 年 4 月至 1998 年 4 月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998 年 4 月至 2007 年 11 月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。2007 年 12 月加入国泰基金管理有限公司，2008 年 12 月起担任公司副总经理。

周向勇，硕士研究生，17 年金融从业经历。1996 年 7 月至 2004 年 12 月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004 年 12 月至 2011 年 1 月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012 年 11 月起任公司副总经理。

李志坚，硕士研究生，21 年金融业从业经历。1992 年 2 月至 1994 年 12 月在美国花旗银行台北分行工作，任财务企划助理；1995 年 1 月至 2000 年 12 月在台湾大华证券公司工作，任债券交易总监；2001 年 1 月至 2004 年 9 月在台湾景顺投信股份有限公司工作，负责投资业务；2004 年 10 月至 2006 年 5 月在台湾保诚投信股份有限公司工作，负责投资业务；2006 年

6 月至 2010 年 4 月在美国纽约人寿台湾子公司工作，任投资长；2010 年 5 月至 2012 年 12 月在台湾富邦投信股份有限公司工作，任投资长；2013 年 1 月起加入国泰基金管理有限公司，任全球投资总监，2013 年 6 月起任公司副总经理。

田昆，博士研究生，10 年证券基金从业经历。2003 年 7 月至 2012 年 8 月在博时基金管理有限公司工作，历任渠道经理、渠道主管、上海分公司副总经理、北京分公司副总经理、市场部总经理、北京分公司及零售业务总经理。2012 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，2012 年 11 月起任公司副总经理。

林海中，硕士研究生，11 年证券基金从业经历。2002 年 8 月至 2005 年 4 月在中国证监会信息中心工作，历任专业助理、主任科员；2005 年 4 月至 2012 年 6 月在中国证监会基金监管部工作，历任主任科员、副处长、处长。2012 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，2012 年 8 月起任公司督察长。

#### 4. 本基金的基金经理

##### （1）现任基金经理

张一格，硕士研究生，CFA，7 年证券从业经历。2006 年 6 月至 2012 年 8 月就职于兴业银行股份有限公司资金营运中心，任投资经理；2012 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，2012 年 12 月起担任国泰民安增利债券型发起式证券投资基金基金经理，2013 年 3 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金及国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

##### （2）历任基金经理

本基金自基金成立以来一直由张一格担任基金经理，无基金经理变更事宜。

#### 5. 投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

李志坚先生：副总经理

周向勇先生：副总经理



黄焱先生：总经理助理

张则斌先生：投资总监

沙骏先生：投资总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

6.上述人员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行资产总额 148,592.14 亿元，较上年末增长 6.34%。2013

年上半年，中国建设银行实现净利润1,199.64亿元，较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%，年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元，较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%，较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元，较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司，海外机构已覆盖到全球14个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5，较上年上升1位；在美国《财富》世界500强排名第50位，较上年上升27位；在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2，较上年提升11位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 225 人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零

售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 311 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

### （四）基金托管人的内部控制制度

#### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

#### 3. 内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存

放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

##### 2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、申购赎回代理券商

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区商城路618号	
		法定代表人：万建华	联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161	传真：021-38670161

		客服电话：400-888-8666	网址： <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
2	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼	
		法定代表人：王常青	联系人：魏明
		电话：010-85130588	传真：010-65182261
		客服电话：400-888-8108	网址： <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>
3	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	
		法定代表人：宫少林	联系人：林生迎
		电话：0755-82943666	传真：0755-82943636
		网址： <a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>	
		客服电话：400-888-8111/95565	
4	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
		法定代表人：陈有安	联系人：田薇
		电话：010-66568430	传真：010-66568990
		客服电话：400-8888-888	网址：
5	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市淮海中路98号	
		法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
		电话：021-23219000	传真：021-23219100
		客服电话：400-888-8001（全国），021-95553	
		网址： <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>	
6	申银万国证券股份有限公司	注册地址：上海市常熟路171号	
		法定代表人：丁国荣	联系人：邓寒冰
		电话：021-54033888	传真：021-54038844
		客服电话：021-962505	网址： <a href="http://www.sw2000.com.cn">www.sw2000.com.cn</a>
7	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层	
		法定代表人：张建军	联系人：罗创斌
		电话：020-38286651	传真：020-22373718-1013
		客服电话：400-888-8133	网址： <a href="http://www.wlzq.com.cn">www.wlzq.com.cn</a>
8	东方证券股份有限公司	注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层	
		法定代表人：潘鑫军	联系人：吴宇
		电话：021-63325888	传真：021-63326173

		客服电话：95503	网址： <a href="http://www.dfzq.com.cn">www.dfzq.com.cn</a>
9	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市西藏中路336号	
		法定代表人：郁忠民	联系人：张瑾
		电话：021-53519888	传真：021-53519888
		客服电话：021-962518	网址： <a href="http://www.962518.com">www.962518.com</a>
10	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闻路1508号	
		法定代表人：徐浩明	联系人：刘晨
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：10108998、400-888-8788	
		网址： <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>	
11	宏源证券股份有限公司	注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号	
		法定代表人：冯戎	联系人：李巍
		电话：010-88085858	传真：010-88085195
		客服电话：400-800-0562	网址： <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a>
12	广发证券股份有限公司	注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）	
		办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼	
		法定代表人：孙树明	联系人：黄岚
		电话：020-87555888	传真：020-87555305
		客服电话：95575	网址： <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
13	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座	
		法定代表人：王东明	联系人：陈忠
		电话：010-84588888	传真：010-84865560
		网址： <a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a>	
14	长江证券股份有限公司	注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		法定代表人：胡运钊	联系人：李良
		电话：027-65799999	传真：027-85481900
		客服电话：95579	网址： <a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a>
		网址： <a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a>	

15	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元	
		法定代表人：龙增来	联系人：刘毅
		电话：0755-82023442	传真：0755-82026539
		网址： <a href="http://www.china-invs.cn">www.china-invs.cn</a>	客服电话：400-600-8008、0755-82026539
16	华宝证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层	
		法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
		电话：021-68778081	传真：021-68778117
		客服电话：400-820-9898	网址： <a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>
17	信达证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人：高冠江	联系人：唐静
		电话：010-88656100	传真：010-88656290
		客服电话：400-800-8899	网址： <a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>
18	德邦证券有限责任公司	注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼	
		法定代表人：姚文平	联系人：罗芳
		电话：021-68761616	传真：021-68767981
		客服电话：4008888128	网址： <a href="http://www.tebon.com.cn">www.tebon.com.cn</a>
19	中航证券有限公司	注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼	
		法定代表人：杜航	联系人：戴蕾
		电话：0791-86768681	传真：0791-86770178
		客服电话：400-8866-567	网址： <a href="http://www.avicsec.com">www.avicsec.com</a>
20	西南证券股份有限公司	注册地址：重庆市江北区桥北苑8号	
		法定代表人：余维佳	联系人：张煜
		电话：023-63786141	传真：023-63786212
		网址： <a href="http://www.swsc.com.cn">http://www.swsc.com.cn</a>	
21	山西证券股份有限公司	注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人：侯巍	联系人：郭熠
		电话：0351-8686659	传真：0351-8686619

		客服电话：400-666-1618、 95573	网址： <a href="http://www.i618.com.cn">www.i618.com.cn</a>
22	中银国际证券有 限责任公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	
		法定代表人：许刚	联系人：王炜哲
		电话：021-20328309	传真：021-50372474
		客服电话：4006208888	网址： <a href="http://www.bocichina.com">www.bocichina.com</a>
23	西藏同信证券有 限责任公司	注册地址：拉萨市北京中路101号	
		法定代表人：贾绍君	

## 2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。

## （二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

法定代表人：金颖

联系人：陈龙

电话：（021）58876741

传真：（021）68870311

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传 真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明



（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

经办注册会计师：汪棣、屈斯洁

联系人：魏佳亮

## 四、基金名称

国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金

## 五、基金类型和存续期限

- 1.基金类型：债券型
- 2.基金运作方式：交易型开放式
- 3.基金的存续期间：不定期

## 六、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 七、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份国债和备选成份国债。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序

后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份国债和备选成份国债的资产比例不低于基金资产净值的 90%。

## 八、投资策略

本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。

通过对标的指数中各成份国债的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的国债构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证 5 年期国债指数收益率。

如果中证指数有限公司变更或停止上证 5 年期国债指数的编制及发布，或者上证 5 年期国债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证 5 年期国债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，在履行适当程序后有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。

## 十、风险收益特征

本基金属于债券基金，其预期收益及风险水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金属于国债指数基金，是债券基金中投资风险较低的品种。

本基金采用优化抽样复制策略，跟踪上证 5 年期国债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## 十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2013 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2013 年 6 月 30 日。本报告所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,304,574,235.44	97.10
	其中：债券	1,304,574,235.44	97.10
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	14,000,000.00	1.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,097,798.07	0.60
7	其他各项资产	16,852,078.74	1.25
8	合计	1,343,524,112.25	100.00

注：上述债券投资包括可退替代款估值增值。

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,304,574,235.44	97.19
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,304,574,235.44	97.19

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019301	13 国债 01	6,304,080	626,625,552.00	46.68
2	019303	13 国债 03	3,244,490	325,065,453.10	24.22
3	019308	13 国债 08	2,565,310	255,120,079.50	19.01
4	130003	13 付息国债 03	300,000	30,057,000.00	2.24
5	130013	13 付息国债 13	300,000	29,730,000.00	2.21

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

9、投资组合报告附注

（1）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	659.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,851,419.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,852,078.74

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

本基金业绩截止日为2013年6月30日，并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自 2013 年 3 月 5 日至 2013 年 6 月 30 日	0.85%	0.15%	0.22%	0.12%	0.63%	0.03%

## 十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；

2. 基金托管人的托管费；
3. 基金的指数许可使用费；
4. 基金上市费及年费；
5. 基金财产拨划支付的银行费用；
6. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
7. 基金份额持有人大会费用；
8. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
9. 基金的证券交易费用；
10. 基金的开户费用、账户维护费用
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，

自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3. 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费，E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的规定，指数许可使用费的收取下限为每季人民币 25,000 元（即不足 25,000 元部分按照 25,000 元收取）。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时通知基金托管人，并依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

4. 除管理费、托管费和指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### (四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

#### (六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2013 年 2 月 8 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“释义”部分中《基金法》及《销售办法》含义；
- 3、更新了“三、基金管理人”中的相关内容；
- 4、更新了“四、基金托管人”中的相关内容；
- 5、更新了“五、相关服务机构”中基金份额发售机构的相关信息及审计基金财产的会计师事务所名称；
- 6、更新了“六、基金的募集”中的相关内容；
- 7、更新了“七、基金合同的生效”中的相关内容；
- 8、更新了“八、基金份额折算与变更登记”中的相关内容；
- 9、更新了“九、基金份额的交易”中的相关内容；
- 10、更新了“十、基金份额的申购与赎回”中的相关内容；
- 11、新增了“十一、基金的投资”中基金投资组合报告，数据截止至2013年6月30日；
- 12、新增了“十二、基金的业绩”，数据截止至2013年6月30日；
- 13、更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”的相关内容；
- 14、更新了“二十四、其他应披露的事项”，新增了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站 [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司

2013 年 10 月 19 日



